

Fecha de publicación: 28 de Enero de 2004
 Fecha de Información: 26 de Enero de 2004 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$95.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35.5	29.6	4.1	10.0	39.5
15-35	17.5	25.5	14.5	6.5	32.0
36-60	6.0	6.1	0.1	-	6.1
61-90	0.4	0.0	0.0	0.4	0.4
91-180	2.6	0.3	0.3	2.6	2.8
>180	12.0	3.0	3.0	12.0	15.0
Total	73.9	64.4	21.9	31.4	95.9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8.3 %	9.1 %
15-35	6.2 %	7.3 %
36-60	6.6 %	6.2 %
61-90	-1.5 %	-0.4 %
91-180	6.1 %	4.0 %
>180	5.0 %	6.8 %
Total	7.0 %	7.8 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	26 al 30 de Enero				2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	45	57	348	340	23	56	464	297	11	46	222	137
Real	35	23	142	150	43	10	71	237	43	8	89	175
Total	80	80	490	490	66	66	534	534	54	54	311	311

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (Plazo/365)) - 1

³ A partir del 27 de enero se presenta la proyección de vencimientos.